(上接B720版)

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600309	万华化学	2017年12月5日	重大资产重组	37.67	-	-	62,900	1,429,284.62	2,369,443.00	-
600664	哈药股份	2017年9月28日	重大资产重组	6.11	2018年2月27日	6.00	283,400	1,637,385.70	1,731,574.00	-
600332	白云山	2017年10月31日	重大资产重组	32.14	2018年1月8日	30.15	34,400	998,919.00	1,105,616.00	-
000688	建新矿业	2017年9月6日	重大事项	10.13	2018年2月7日	9.86	17,400	190,896.00	176,262.00	-
002919	名臣健康	2017年12月28日	重大事项	35.26	2018年1月2日	38.79	821	10,311.76	28,948.46	-

注：本基金截至2017年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

无

7.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

无

7.4.9 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于2017年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为365,457.60元，属于第二层次的余额为5,432,596.71元，无属于第三层次的余额。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)，或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2017年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)增值税

根据财政部、国家税务总局于2016年12月21日颁布的财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。

根据财政部、国家税务总局于2017年6月30日颁布的财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

此外，财政部、国家税务总局于2017年12月25日颁布的财税[2017]90号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自2018年1月1日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

上述税收政策对本基金截至2017年12月31日止的财务状况和经营成果无影响。

(3)除公允价值和增值税外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 年度财务报表(转型前)

7.1 资产负债表(转型前)

会计主体：华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017年9月26日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017年9月26日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	18,954,238.04
结算备付金		187,279.80
存出保证金		45,213.92
交易性金融资产	7.4.7.2	213,281,759.05
其中：股票投资		213,281,759.05
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		124,275.31
应收利息	7.4.7.5	2,329.11
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		232,595,095.03
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年9月26日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		249,977.98
应付托管费		41,663.00
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	194,117.41
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	251,662.19
负债合计		737,420.58
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	200,372,907.72
未分配利润	7.4.7.10	31,484,766.73
所有者权益合计		231,857,674.45
负债和所有者权益总计		232,595,095.03

注：

1. 报告截止日2017年9月26日(基金合同失效前日)，基金份额净值1.1571元，基金份额总额200,372,907.72份。

2. 本财务报表的实际编制期间为2017年2月16日（基金合同生效日)至2017年9月26日(基金合同失效前日)止期间。

7.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017年2月16日至2017年9月26日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017年2月16日至2017年9月26日
一、收入		34,724,841.54
1.利息收入		705,433.02
其中：存款利息收入	7.4.7.11	187,095.79
债券利息收入		0.00
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		518,337.23
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		20,810,467.68
其中：股票投资收益	7.4.7.12	17,649,828.36
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	3,160,639.32
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	13,208,492.70
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	448.14
减：二、费用		3,259,550.87
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,948,029.30
2. 托管费	7.4.10.2.2	324,671.54
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-
4. 交易费用	7.4.7.19	717,059.55
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	7.4.7.20	269,790.48
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		31,465,290.67
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		31,465,290.67

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017年2月16日至2017年9月26日

单位：人民币元

项目	本期 2017年2月16日至2017年9月26日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	200,250,914.93	-	200,250,914.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	31,465,290.67	31,465,290.67
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	121,992.79	19,476.06	141,468.85
其中：1.基金申购款	188,237.41	28,524.09	217,761.50
2.基金赎回款	-67,244.62	-9,048.03	-76,292.65
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	200,372,907.72	31,484,766.73	231,857,674.45

注：报告附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

_____韩勇_____ _____房伟力_____ _____赵景云_____

基金管理人负责人　　主管会计工作负责人　　会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]1499号《关于准予华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》和机构部函[2016]2727号《关于华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金延期募集备案的回函》核准，由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币200,232,903.23元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第139号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2017年2月16日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为200,250,914.93份基金份额，其中认购资金利息折合18,011.70份基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金以通讯方式自2017年8月28日起至2017年9月26日止期间召开了基金份额持有人大会，会议审议通过了《关于修改华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同的议案》。本基金的基金管理人于2017年9月28日发布了《华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。自2017年9月27日起，由《华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》修订而成的《华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效，原《华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》同日起失效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(国债、金融债、企业/公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金持有的股票资产占基金资产的比例为0-95%，其中投资于本基金界定的国企改革主题方向的相关证券比例不低于非现金基金资产的80%；其中，本基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为中证国有企业改革指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%。

本财务报表由本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于2018年3月26日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

经中国证监会批准，基金管理人华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型证券投资基金，因此本基金财务报表仍以持续经营假设为编制基础。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2017年2月16日(基金合同生效日)至2017年9月26日(基金合同失效前日)止期间的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2017年9月26日(基金合同失效前日)的财务状况以及2017年2月16日(基金合同生效日)至2017年9月26日(基金合同失效前日)止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2017年2月16日(基金合同生效日)至2017年9月26日(基金合同失效前日)止期间。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易日最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1)具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2)交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)对证券投资基金管理人运用基金买卖股票的转让收入免征增值税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票的差价收入，股票的股息、红利收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华泰柏瑞基金管理有限公司(“华泰柏瑞基金”)	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
PineBridge Investment LLC	基金管理人的股东
苏州新区高新技术产业股份有限公司	基金管理人的股东
华泰联合证券有限责任公司	-
(“华泰联合证券”)	基金管理人的股东华泰证券的控股子公司
柏瑞爱建资产管理(上海)有限公司	基金管理人的控股子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年2月16日至2017年9月26日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华泰证券	247,540,605.73	46.37%

7.4.8.1.2 权证交易

注：无

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年2月16日至2017年9月26日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	228,052.08	46.26%	11,655.71	6.00%

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年2月16日至2017年9月26日
当期发生的基金应支付的管理费	1,948,029.30
其中：支付销售机构的客户维护费	213.58

注：支付基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值×1.50%÷当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年2月16日至2017年9月26日
当期发生的基金应支付的托管费	324,671.54

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费＝前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

7.4.8.2.3 销售服务费

注：本期无数据。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本报告期，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年2月16日至2017年9月26日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	18,954,238.04	174,390.37

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

注：无

7.4.9 期末(2017年9月26日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.9.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	说明
603619	中曼石油	2017年8月4日	2017年11月17日	新股未上市	22.61	22.61	1,701	38,459.61	38,459.61	-
603367	辰欣药业	2017年9月21日	2017年9月29日	新股未上市	11.66	11.66	2,917	34,012.22	34,012.22	-
603103	横店影视	2017年9月26日	2017年10月12日	新股未上市	15.45	15.45	2,021	31,224.45	31,224.45	-
603378	亚士创能	2017年9月21日	2017年9月28日	新股未上市	12.94	12.94	1,433	18,543.02	18,543.02	-
601086	国芳集团	2017年9月22日	2017年9月29日	新股未上市	3.16	3.16	5,799	18,324.84	18,324.84	-
002902	铭普光磁	2017年9月22日	2017年9月29日	新股未上市	14.13	14.13	1,270	17,945.10	17,945.10	-
300705	九典制药	2017年9月25日	2017年10月10日	新股未上市	10.37	10.37	1,073	11,127.01	11,127.01	-

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000688	建新矿业	2017年9月6日	重大事项	10.95	2018年2月7日	9.86	17,400	190,896.00	190,530.00	-

注：本基金截至2017年9月26日(基金合同失效前日)止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于2017年9月26日(基金合同失效前日)，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为212,921,592.80元，属于第二层次的余额为360,166.25元，无属于第三层次的余额。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2017年9月26日(基金合同失效前日)，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告(转型后)

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	5,798,054.31	44.25
	其中：股票	5,798,054.31	44.25
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	7,280,743.97	55.57
8	其他各项资产	23,317.26	0.18
9	合计	13,102,115.54	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	176,262.00	1.44
C	制造业	5,621,792.31	45.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	5,798,054.31	47.29

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

8.2.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600309	万华化学	62,900	2,369,443.00	19.32
2	600664	哈药股份	283,400	1,731,574.00	14.12
3	600332	白云山	34,400	1,105,616.00	9.02
4	002920	德赛西威	4,569	178,784.97	1.46
5	000688	建新矿业	17,400	176,262.00	1.44
6	002918	蒙娜丽莎	1,512	84,218.40	0.69
7	300735	光弘科技	3,255	46,839.45	0.38
8	603477	振静股份	1,955	37,027.70	0.30
9	002919	名臣健康	821	28,948.46	0.24
10	603161	科华控股	1,239	20,753.25	0.17

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于www.Huatai-pb.com网站的半年度报告正文。

8.3 报告期内股票投资组合的重大变动

8.3.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	600888	上海石化	9,231,214.18	75.28%
2	000002	万科A	8,458,779.80	68.98%
3	000338	潍柴动力	8,230,434.87	67.12%
4	600019	宝钢股份	8,177,738.92	66.69%
5	600383	金地集团	7,760,959.50	63.29%
6	002146	荣盛发展	7,602,681.16	62.00%
7	002195	二三四五	7,323,887.28	59.73%
8	601318	中国平安	7,096,576.03	57.88%
9	000415	渤海金控	6,958,615.31	56.75%
10	600816	安信信托	6,773,988.42	55.24%
11	600153	建发股份	6,699,600.63	54.64%
12	000069	华侨城A	6,532,806.37	53.28%
13	002385	大北农	6,510,415.26	53.10%
14	601633	长城汽车	6,491,977.00	52.94%
15	000709	河钢股份	6,301,116.09	51.39%
16	601628	中国人寿	5,857,853.00	48.02%
17	601006	大秦铁路	5,018,974.73	40.93%
18	600585	海螺水泥